三大現貨買賣超(億元)

(台幣29.942元 升值1分)

	外 資	投 信	自 營	合 計
上市	+41.01	+6.81	+5.84	+53.66
上櫃	+10.20	+3.62	+4.70	+18.52

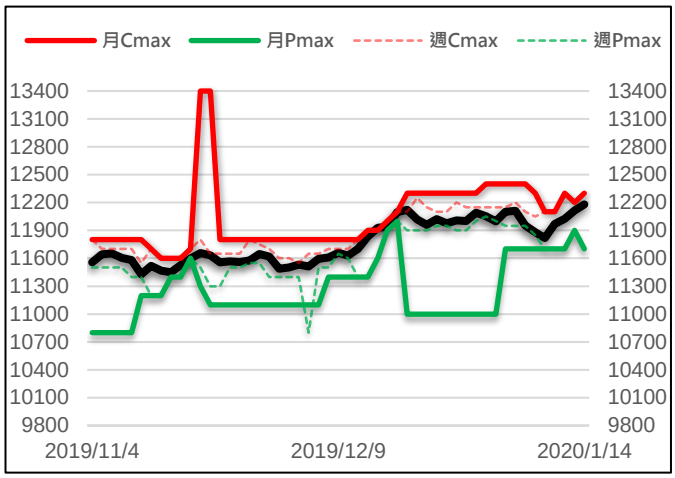
現貨漲跌家數

	上漲家數	漲家權重	下跌家數	跌家權重
上市股票	462	66.27%	316	23.70%
上櫃股票	388	63.68%	272	28.91%

台指選擇權大量區與未平倉量

	月選大量區 / OI		週選大量區 / OI	
CALL	12300	38420	-	-
PUT	11700	24975	-	-

加權指數 VS 選擇權最大未平倉量



永豐期貨研調

三大法人期權部位口數 (單位：口)

合約	外資			投信			自營		
	淨部位	淨部增減	佔市場%	淨部位	淨部增減	佔市場%	淨部位	淨部增減	佔市場%
台 指	+39879	-2514	34.4%	-25100	+280	-21.6%	-828	-1242	-0.7%
電 子	+1113	-194	33.9%	+73	-3	2.2%	-7	+137	-0.2%
金 融	-1581	-54	-62.7%	+5	0	0.2%	+209	-42	8.3%
CALL	-2191	+1116	-0.7%	-67	+50	-0.0%	-20162	-347	-6.0%
PUT	+25012	+7433	4.9%	-97	0	-0.0%	-73230	-14040	-14.5%

前十大交易人期權淨部位口數 (單位：口)

商 品	特定法人				非特定法人				全市場
	近月	增減	其他月	增減	近月	增減	其他月	增減	未平倉量
台 指	+7531	-3771	+3811	+2666	-6445	-2412	+3402	+2527	115937
電 子	+465	-832	+934	+603	-560	+600	-622	-473	3286
金 融	-210	+296	-1308	-398	-11	-184	+589	+261	2523
CALL	+1008	+2948	+3431	-602	-23099	-6983	+11224	+6178	334734
PUT	-17658	-2401	+9624	-5767	+28218	-6015	+3852	+2971	506310

台指期現貨收盤行情表

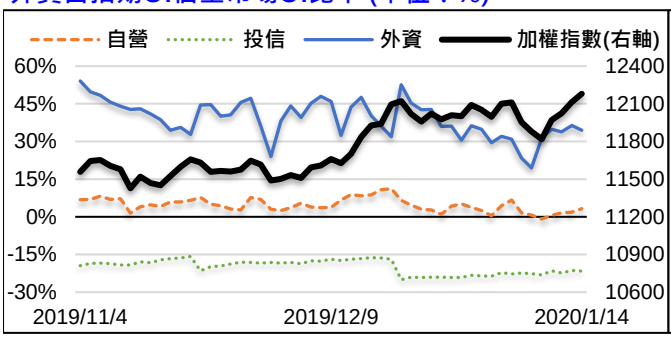
合約	開盤	最高	最低	結算	漲跌	漲跌幅	成交量	未平倉	OI增減
加權指數	12161.73	12186.62	12140.27	12179.81	+66.39	+0.55%	1535.7億		
台指期一月	12176	12199	12148	12181	+65	+0.54%	104397	39121	-19689
台指期二月	12156	12171	12122	12155	+59	+0.49%	37503	61784	+16803
小型台指一月	12180	12200	12148	12181	+65	+0.54%	72957	21639	-4449
小型台指二月	12158	12171	12122	12155	+59	+0.49%	13418	12439	+2155
小型台指(週)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
電子指數	538.28	539.44	537.29	539.40	+4.68	+0.88%	1130.93億		
電子期一月	538.30	539.95	537.55	539.30	+4.8	+0.90%	3008	1667	-854
電子期二月	537.70	538.80	536.60	538.30	+4.9	+0.92%	1645	1611	+962
金融指數	1373.56	1379.77	1372.68	1377.42	+5.42	+0.40%	73.65億		
金融期一月	1378.0	1380.4	1373.6	1376.2	+5.2	+0.38%	1383	747	-473
金融期二月	1373.8	1378.0	1372.0	1374.8	+6	+0.44%	895	1772	+511
櫃買指數	148.38	149.62	148.38	149.62	+1.35	+0.91%	362.35億		
櫃買期二月	148.80	149.15	148.80	149.10	+0.90	+0.61%	32	72	+9
非金電指數	12590.9	12607.9	12558.7	12586.8	-4.19	-0.03%	211.84億		
非金電期二月	12613	12613	12547	12562	-36	-0.29%	56	116	+34

永豐期貨股份有限公司 100 台北市重慶南路一段2號8F / 105年金管期總字第010號
本資料僅供參考，客戶應審慎考量本身之需求與投資風險，本公司恕不負任何法律責任，亦不作任何保證。未經授權，禁止轉載節錄。

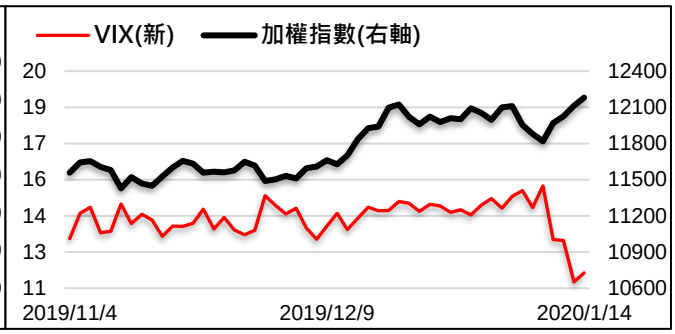
美指期現貨收盤行情表 (現貨為前一晚美股收盤數據)

合約	開盤	最高	最低	結算	漲跌	漲跌幅	成交量	未平倉	OI增減
道瓊指數	28869.01	28909.91	28819.43	28907.05	+83.28	+0.29%			
道瓊三月	28928	28930	28855	28866	+10	+0.03%	1247	4461	-97
標普500指數	3271.13	3288.13	3268.43	3288.13	+22.78	+0.70%			
標普三月	3294.75	3296.25	3288	3288.5	+15.25	+0.47%	152	787	+10
Nasdaq 100指數	9007.94	9071.53	8991.35	9070.65	+104.01	+1.16%			
那斯達十二月	9109	9113	9082	9089	+78	+0.87%	428	1160	+81

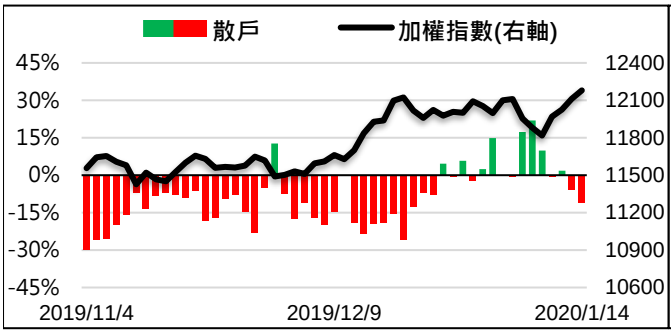
外資台指期OI佔全市場OI比率 (單位：%)



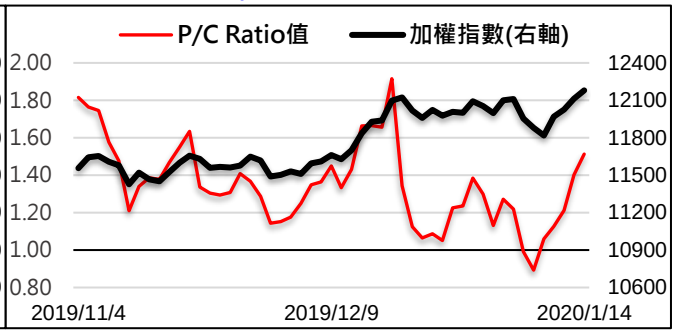
VIX波動率指數 11.64 +0.38



散戶小台指佔全市場OI比率 -11.12% -5.34%



全月份台指選擇權P/C Ratio值 1.51 +0.11



永豐期貨研調

電子權值股齊揚 台股連四漲挑戰前高

台指期週二上漲65點至12181點。價差方面，台指期正價差縮至1.19點，電子期逆價差縮至-0.1點，金融期逆價差擴至-1.22點。現貨部分，三大法人買超53.66億元；而在台指期淨部位方面，三大法人淨多單減少3476口至13951口，其中外資多單減碼超過空單減碼，淨多單減少2514口至39879口；十大交易人中的特定法人全月份台指期淨多單減少1105口至11342口。

週一消息傳出美國財政部將中國排除「匯率操縱國」名單之外，加上市場樂觀看待第一階段貿易協議，終場美股四大指數全數收紅，道瓊、標普指數漲幅0.28%、0.70%，其餘Nasdaq、費半指數漲幅則高達1.04%、1.31%，也激勵台指期夜盤上漲0.46%至12172點作收。週二美股電子盤繼續走揚，激勵台指期早盤跳高開出表態，現貨開盤後由台積電、大立光、鴻海等電子權值股領軍上攻，而昨日強漲的金融股也持續向上墊高，激勵台指期一度攻高，雖然未能順利站上12200關卡，但是台股拉回賣壓並不重，尾盤更是大筆買單敲進多檔權值股，激勵加權指數終場以上漲0.55%至12179.81點作收。整體而言，目前台股技術面偏多力道強勁，不過從台指期委買委賣口數可以發現這兩天市場上都有空單轉倉至2月合約的跡象，因此週三結算後仍需樂觀中帶點謹慎為宜。

選擇權未平倉量部分，買權未平倉最大量集中在12300點，賣權未平倉最大量集中在11700點。全月份未平倉量put/call ratio值由1.4升至1.51。VIX指數上漲0.38至11.64。整體選擇權籌碼面持續有利多方上攻。 (永豐期貨研調)

永豐期貨股份有限公司 100 台北市重慶南路一段2號8F / 105年金管期總字第010號
本資料僅供參考，客戶應審慎考量本身之需求與投資風險，本公司恕不負任何法律責任，亦不作任何保證。未經授權，禁止轉載節錄。

全市場台指選擇權成交與未平倉量統計

近月份	P/C ratio = 141.87% ▲				所有月份	P/C ratio = 151.26% ▲			
	成交量	增減	未平倉量	增減		成交量	增減	未平倉量	增減
Call	252825	-47907	246663	-982	Call	367042	-16242	334734	+10939
Put	292741	-101316	349943	+32806	Put	411870	-79284	506310	+52687

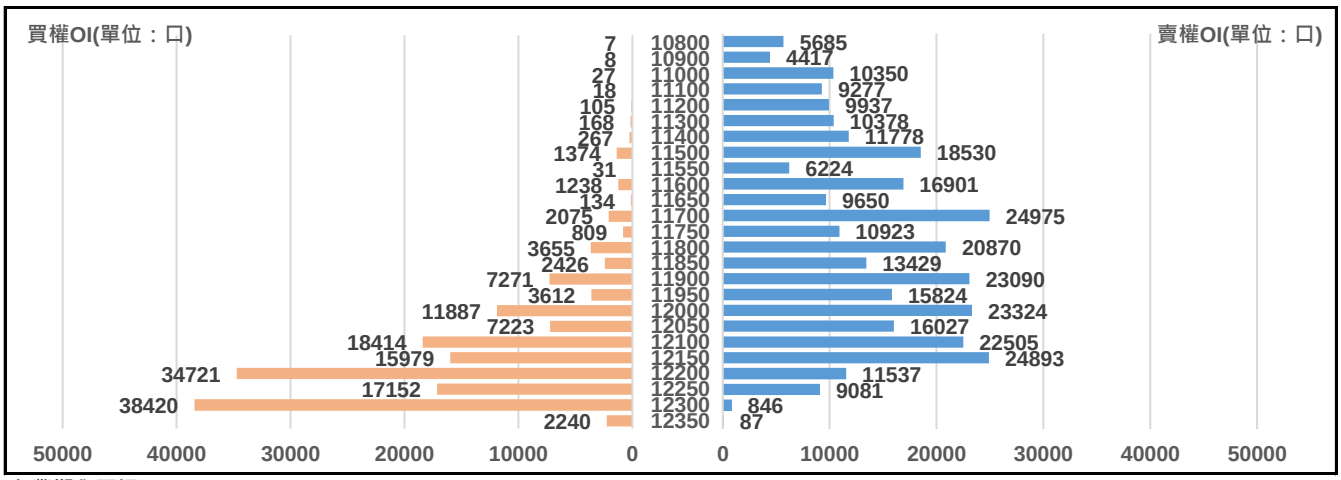
一月份台指選擇權

買權 IV = 15.05 ▲							賣權 IV = 18.63 ▲					
Delta	OI增減	OI	成交量	漲跌	收盤	履約價	收盤	漲跌	成交量	OI	OI增減	Delta
1.000	-4	809	6	+61	431	11750	0.9	-0.6	2315	10923	+267	0.000
1.000	-139	3655	391	+61	381	11800	1	-0.6	3516	20870	-796	0.000
1.000	-160	2426	253	+61	332	11850	1.2	-0.9	3584	13429	-1486	0.000
1.000	-764	7271	1017	+61	282	11900	1.5	-2	14180	23090	-3034	0.000
1.000	-771	3612	1469	+60	232	11950	1.9	-3.5	16138	15824	-2468	0.000
0.995	-2645	11887	4949	+59	184	12000	2.6	-5.5	20175	23324	-1254	-0.005
0.968	-2292	7223	8551	+52	135	12050	3.7	-12.8	31322	16027	-413	-0.032
0.873	-5028	18414	28173	+38.5	88	12100	7.6	-23.9	44612	22505	+7232	-0.127
0.666	-3789	15979	58903	+21.5	46	12150	14	-44	64886	24893	+19365	-0.334
0.389	+244	34721	68179	+8.5	18.5	12200	36.5	-56.5	49058	11537	+9441	-0.611
0.162	+7565	17152	40733	+2.2	6.2	12250	75	-62	21353	9081	+8854	-0.838
0.045	+5836	38420	24925	+0.7	2.2	12300	121	-65	2755	846	+298	-0.955
0.008	+1669	2240	5883	+0.4	1.4	12350	171	-64	151	87	+56	-0.992
0.001	-772	27301	3508	+0.2	0.6	12400	221	-64	85	419	-43	-0.999
0.000	0	550	576	0	0.6	12450	271	0	0	0	0	-1.000

二月份台指選擇權

買權 IV = 10.22 ▲							賣權 IV = 13.45 ▼					
Delta	OI增減	OI	成交量	漲跌	收盤	履約價	收盤	漲跌	成交量	OI	OI增減	Delta
0.759	-307	1371	977	+44	335	11900	82	-14	7233	6969	+3871	-0.241
0.678	-236	3605	900	+41	263	12000	108	-20	3134	3622	+1337	-0.322
0.589	-187	5048	2181	+34	196	12100	143	-24	2323	2062	+699	-0.411
0.495	+571	5121	3322	+27	140	12200	187	-32	647	959	+317	-0.505
0.402	+3134	11479	5557	+24	98	12300	241	-40	528	472	+334	-0.598
0.315	+1896	7260	5268	+18	64	12400	310	-40	137	170	+101	-0.685
0.238	+802	6188	4522	+12	38.5	12500	383	-49	19	85	+12	-0.762

一月份選擇權未平倉量統計圖



永豐期貨研調

永豐期貨股份有限公司 100 台北市重慶南路一段2號8F / 105年金管期總字第010號
本資料僅供參考，客戶應審慎考量本身之需求與投資風險，本公司恕不負任何法律責任，亦不作任何保證。未經授權，禁止轉載節錄。

讓您 揚帆期海，掌握先機

會員享有以下超值內容

即時簡訊發送
程式追蹤多種國際商品期貨，
獲利風險面面俱到。

每週關鍵報告
掌握全球原物料動向，
投資效率高人一等。

季度投資趨勢
精準預測長期趨勢，
獲利大滿載。

論壇講座特約
與名師對談，免收費
且享有優先報名權利。

會期	一季	半年	一年
費用	2500	4500	7000
平均每日只要	29	24	19

專案聯絡人：02-2382-3761 高先生

警語與功能限制：

- 下單系統及輔助工具僅供參考，投資人仍需自行判斷，任何系統參數均需由投資人自行設定，假使資料內容錯誤，延誤或中斷傳輸，而導致交易損失，投資人應自行負責，本公司不負任何法律責任。
- 課程內容資料內容均採用特定軟體，以歷史數據進行繪製及統計，過去之績效及表現不可作為日後獲利之保證。
- 期權交易財務槓桿高，投資人應依個人財務狀況審慎評估所能承擔之風險。
- 文中所提及之全球資訊為主管機關核准之所有國外期貨市場之商品。

永豐金證券 SinoPac Securities　永豐期貨 SinoPac Futures

永豐金證券股份有限公司 | 台北市重慶南路一段二號7、18、20樓 | 0800-038-123·02-6630-8899
永豐期貨股份有限公司 | 台北市重慶南路一段二號8樓 | 02-2381-1799
104年金管證總字第0045號(永豐金證券) | 105年金管期總字第010號(永豐期貨)

本資料僅供參考，客戶應審慎考量本身之需求與投資風險，本公司恕不負任何法律責任，亦不作任何保證。未經授權，禁止轉載節錄。